

Central Daily Market Report

2022年3月28日(月)
セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位: 億円	2022年3月28日 需給速報	2022年3月29日 需給予想	2022年3月30日 当社予想
銀行券	0	▲ 700	0
財政	3,900	14,100	14,000
資金過不足	3,900	13,400	14,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 4,300
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		600	
CP等買入		▲ 200	▲ 400
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援 社債等買入	800		
新型コロナウイルス対応金融支援特別 気候変動対応オペ	287,700	▲ 241,800	
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 300	300	300
*ドル資金供給用担保提供			
当預増減	50,400	13,900	9,700
当座預金残高	5,529,500	5,543,400	5,553,100
準備預金残高	4,868,300		
積み終了先	4,867,900		3月29日以降の残り所要積立額
超過準備	4,867,900		積数 5,200
非準備預金先	661,200		1日平均 300
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額			3,775,500
準備預金進捗率	実績	99.86%	日数 41.94%

●2022年3月28日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.01~▲0.001%での調達で始まった。週末要因の剥落等があったもののレートは下がらず、引き続き堅調に推移した。一巡後も朝方と同水準のレートでの出会いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートタームでの引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.100~▲0.085%程度での出会い。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

<短国市場>

28日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP市場は、月末発行の前倒し入札分を含めて複数の調達を実施された。発行レートは、横ばい圏で推移しており、銘柄による違いが少なかった。CP等買入オペは、足切レート▲0.013%、平均落札レート▲0.010%といずれも前回から上昇する結果となった。応札額12,287億円と、前回から僅かに減少した。

●短期金融市場関連指標

2022/3/28	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位: %	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.092	0.250	0.015	27,943.89	▲ 205.95	122.26-27	123.92-93
T/N							-	▲ 0.091						
S/N			▲ 0.003				-	-						
1W							-	▲ 0.094						
2W							-	▲ 0.094						
3W	0.001	0.010	0.006				-	▲ 0.096						
1M			▲ 0.001				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.087	▲ 0.099						
6M							▲ 0.085	▲ 0.103						
1Y							▲ 0.065	▲ 0.109						
									日付	3/18	3/22	3/23	3/24	3/25
									日銀当預残	5,340,100	5,399,800	5,421,100	5,447,000	5,479,100
									準備預金残	4,692,000	4,745,200	4,773,500	4,799,800	4,828,500
									マネタリーベース	6,586,300	6,645,900	6,667,500	6,694,600	6,726,900
									無担O/N加重平均	▲0.006%	▲0.005%	▲0.006%	▲0.005%	▲0.004%
									コール市場残高	218,476	210,792	229,066	224,452	233,704
									うち無担	189,508	181,534	199,522	195,279	203,577
									うちO/N	101,680	95,701	110,119	102,996	106,164
									うち有担	28,968	29,258	29,544	29,173	30,127

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●オペ結果

種類	オファー額 (億円・ 百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付 利率	応札総額 (億円・ 百万ドル)	落札総額 (億円・ 百万ドル)	按分レート ・利回較差 ・価格較差	全取レート ・利回較差 ・価格較差	平均落札レート ・利回較差 ・価格較差	按分 比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/3/28	2022/3/29	▲ 0.350	260	260		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/28	2022/3/29	▲ 0.350	25	25		▲ 0.350	▲ 0.350	
CP等買入	5,000	2022/3/31			12,287	4,995	▲ 0.013		▲ 0.010	42.5
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/3/29			0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/3/29			645	645				

※1 国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)の固定利回較差は、0.015%。この結果、10年利付国債365回の買入利回りは、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオファー。
※2 国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)の固定利回較差は、0.015%。この結果、10年利付国債365回の買入利回りは、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2022年3月29日の予定

*決定会合における主な意見(3月17、18日分)	*米国1月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*40年利付国債入札 (6,000億円、3/30発行)
*2月の完全失業率(市場予想: 2.8%)	*米国3月のCB消費者信頼感指数	
*2月の有効求人倍率(市場予想: 1.20倍)		

◆本資料は信頼できるとされる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はおお客様自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入